易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金更新的招募说明书摘要

基金管理人：易方达基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
二〇一一年七月

重要提示

本基金为易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“深证100ETF”）的联接基金，将绝大部分基金财产投资于深证100ETF，实现对业绩比较基准的紧密跟踪，追求跟踪偏离度及跟踪误差最小化，并采用开放式基金的运作方式。本基金根据2009年9月16日中国证券监督管理委员会《关于核准易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的批复》（证监许可[2009]947号）和2009年10月21日《关于深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集时间安排的确认函》（基部函[2009]677号）的核准，进行募集。本基金的基金合同于2009年12月1日正式生效。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

基金管理人保证《招募说明书》的内容真实、准确、完整。本《招募说明书》经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等等。投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

投资有风险，投资者投资本基金时应认真阅读招募说明书；基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本基金为深证100ETF的联接基金，二者既有联系也有区别：①在基金的投资方法方面，深证100ETF主要采取完全复制法，直接投资于标的指数的成份股；而本基金则采取间接的方法，通过将绝大部分基金财产投资于深证100ETF，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。②在交易方式方面，投资者既可以像股票一样在交易所市场买卖深证100ETF，也可以按照最小申赎单位和申赎清单的要求，实物申赎深证100ETF；而本基金则像普通的开放式基金一样，通过基金管理人及代销机构按未知价法进行基金的申购与赎回。

本基金与深证100ETF业绩表现可能出现差异，可能引发差异的因素主要包括：①达规对投资比例的要求，深证100ETF作为一种特殊的基金品种，可将全部或接近全部的基金资产，用于跟踪标的指数的表现；而本基金作为普通的开放式基金，仍需将不低于基金资产净值5%的资产投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券。②申赎赎回的影响。深证100ETF采取实物申赎的方式，申赎赎回对基金净值影响较小；而本基金申赎采取现金方式，大额申赎可能会对基金净值产生一定冲击。

本招募说明书中基金投资组合报告和基金业绩中的数据已经本基金托管人复核。除非另有说明，本招募说明书所载内容截止日为2011年6月1日，有关财务数据截止日为2011年3月31日，净值表现截止日为2010年12月31日。本报告中财务数据未经审计。

一、基金管理人

（一）基金管理人基本情况

1.基金管理人：易方达基金管理有限公司
注册地址：广东省珠海市香洲区情侣路428号九洲港大厦4001室
办公地址：广州市体育西路189号城建大厦25、26、27、28楼
批准设立机关及批准设立文号：中国证监会，证监基金字[2001]4号
法定代表人：梁棠
设立日期：2001年4月17日
组织形式：有限责任公司
注册资本：12,000万元人民币
存续期限：持续经营
联系人：陈晓梅
联系电话：400 881 8088

2.股权结构：

股东名称	出资比例
广东粤财信托有限公司	1/4
广发证券股份有限公司	1/4
盈峰投资控股集团有限公司	1/4
广东省广晟资产经营有限公司	1/6
广州市广永国有资产经营有限公司	1/12
总　计	100%

（二）主要人员情况

1.董事、监事及高级管理人员

梁棠先生，董事长，硕士，1958年生。曾任广东省财政学校副校长，广东粤财实业发展公司总经理，广东粤财信托投资有限公司副总经理、总经理，广东粤财投资控股有限公司总经理。现任广东粤财投资控股有限公司董事长、易方达基金管理有限公司董事长。2008年1月，当选为政协广东省第十届委员会常委。

叶俊英先生，副董事长、总裁，博士，1963年生。曾任中国南海石油联合服务总公司条法部科员、副科长、科长，广发证券有限责任公司投资银行部总经理、公司董事、副总裁，易方达基金管理有限公司董事、总裁。现任易方达基金管理有限公司副董事长、总裁。

李建勇先生，董事，博士，1957年生。曾任广发证券股份有限公司成都营业部总经理、投资银行部总经理、公司总裁助理、公司副总裁，现任广发证券股份有限公司总裁。

谢亮先生，董事，硕士，1963年生。曾任53011、53061部队财务部门助理员，广州军区生产管理部财务部门助理员、处长，现任广东省广晟资产经营有限公司总经理助理、计划财务部部长。

杨力先生，董事，硕士，1975年生。曾任美的集团空调事业部技术主管、企划经理，佛山顺德百年科技有限公司行政总监，美的空调深圳营销中心区域经理，佛山顺德创佳电器有限公司董事、副总经理，长虹空调广州营销中心营销总监，广东盈峰投资控股集团有限公司战略总监、董事、副总裁，现任盈峰投资控股集团有限公司董事、首席战略官。

张优造先生，董事，副总裁，硕士，1964年生。曾任南方证券交易中心业务发展部经理，广东证券公司发行上市部经理、深圳证券业务部总经理、基金部总经理。现任易方达基金管理有限公司董事、副总裁兼营运总监。

谢石松先生，独立董事，法学博士，1963年10月生，现任中山大学法学院教授、国际法研究所所长。兼任中国国际私法学会副会长、武汉大学法学院、西北政法大学兼职教授，中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员及专家咨询委员会成员，上海、广州、深圳、厦门、珠海、佛山、肇庆、惠州等仲裁委员会仲裁员。

王化成先生，独立董事，经济学博士，1963年生。曾任中国人民大学商学院助教、讲师、副教授。现任中国人民大学商学院教授、博士生导师。

何小锋先生，独立董事，经济学硕士，1955年生。曾任广东省韶关市教育局干部、中共广东省韶关市委宣传部干部、北京大学经济学院讲师、副教授。现任北京大学经济学院金融系主任、教授、博士生导师。

陈国祥先生，监事会主席，硕士，1963年生。曾任交通银行广州分行江南西营业部经理，广东粤财信托投资公司证券部副总经理、基金部总经理，易方达基金管理有限公司总裁助理兼市场拓展部总经理、市场总监。现任易方达基金管理有限公司监事会主席。

李勤金先生，监事，硕士，1962年生，曾任华南师范大学外语系党总支书记、中国证监会广州证管办处长，现任广州国际控股集团有限公司副总经理、广州市广水国有资产经营有限公司党支部书记、董事长兼总裁，万联证券有限责任公司董事长（兼）、广州银行副董事长（兼）。

廖智先生，监事，硕士，1971年生。曾任广东证券股份有限公司基金部主管、易方达基金管理有限公司综合管理部副总经理、易方达基金管理有限公司人力资源部副总经理，现任易方达基金管理有限公司市场部总经理。

刘晓艳女士，常务副总裁兼市场总监，博士，1969年生。曾任广发证券有限责任公司投资理财部副经理、基金经理，基金投资理财部副总经理、基金资产管理部总经理，易方达基金管理有限公司督察员兼监察部总经理、总经理助理兼市场部总经理、公司副总裁，现任易方达基金管理有限公司常务副总裁兼市场总监。

张南女士，督察长，博士，1970年生。曾任广东省经济贸易委员会主任科员、副处长，2001年10月加入易方达基金管理有限公司，曾任市场拓展部副总经理、督察长兼监察部总经理，现任易方达基金管理有限公司督察长。

2.基金经理

林飞先生，1975年生，经济学博士，曾任融通基金管理有限公司基金经理助理，易方达基金管理有限公司指数与量化投资部经理助理、基金经理助理，易方达沪深300指数基金基金经理（2009年8月26日至2010年12月31日），现任易方达基金管理有限公司指数与量化投资部副总经理、易方达深证100交易型开放式指数基金基金经理（自2006年7月4日起）、易方达50指数基金基金经理（自2007年2月10日起）和易方达深证100交易型开放式指数基金联接基金基金经理（自2009年12月1日起）。

王建军先生，1977年生，统计学博士。曾任汇添富基金管理有限公司数量分析师、易方达基金管理有限公司量化研究员、基金经理助理，现任易方达深证100交易型开放式指数基金基金经理（自2010年9月27日起）、易方达深证100交易型开放式指数基金联接基金基金经理（自2010年9月27日起）、易方达上证中盘交易型开放式指数基金基金经理助理、易方达上证中盘交易型开放式指数基金联接基金基金经理助理。

3.投资决策委员会成员

本公司投资决策委员会成员包括：基金首席投资官陈志民先生、基金投资部总经理吴欣荣先生以及研究部总经理潘峰先生。

陈志民先生，1971年生，法学硕士、公共管理硕士。曾任厦门国际信托投资公司信托部经理助理，南方基金管理有限公司研究员、基金经理助理、投资部副总经理（主管研究），易方达基金管理有限公司基金投资部副总经理、机构理财部总经理、基金投资部总经理、总裁助理、基金投资总监、机构理财部投资经理、基金科瑞基金经理、基金科瑞基金经理、基金科汇基金经理，易方达积极成长证券投资基金基金经理，曾公派美国耶伦比亚大学国际关系学院学习，获公共管理硕士学位，并曾在美国Evergreen Investments基金管理公司国际股票投资部工作。现任易方达基金管理有限公司基金首席投资官。

吴欣荣先生，1975年生，工学硕士，曾任易方达基金管理有限公司研究员、基金投资部副总经理、研究部副总经理、研究部总经理、基金科瑞基金经理、易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金基金经理。现任易方达基金管理有限公司基金投资部总经理、易方达价值精选股票型证券投资基金基金经理。

潘峰先生，1974年生，理学博士。曾任易方达基金管理有限公司行业研究员、机构理财部投资经理、基金经理助理、基金投资部副总经理、基金投资部总经理。现任易方达基金管理有限公司研究部总经理、易方达价值成长混合型证券投资基金基金经理。

4.上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）
住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期：1983年10月31日
变更注册登记日期：2004年8月26日
注册资本：人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元
法定代表人：肖钢
联系人：薛军丽
联系电话：010-68098777
客户服务电话：95595（全国）
传真：010-68560661
网址：www.cebbank.com

（5）广发银行
注册地址：广东省广州市东风东路713号
办公地址：广东省广州市东风东路713号
法定代表人：董建岳
客户服务电话：400-830-8003
网址：www.gdb.com.cn

（6）东莞银行
注册地址：东莞市运河东一路193号
办公地址：东莞市运河东一路193号
法定代表人：廖玉林
联系人：巫渝峰
联系电话：0769-22100193
客户服务电话：0769-96228
网址：www.dongguanbank.cn

（7）上海农村商业银行
注册地址：中国上海市浦东新区浦东大道981号
办公地址：上海市银城中路8号中融碧玉蓝天大厦16层
法定代表人：胡平西
联系人：吴海平
联系电话：021-38576977
开放式基金咨询电话：021-962999
开放式基金业务传真：021-50105124
网址：www.srcb.com

（8）兴业银行
注册地址：福州市湖东路154号中山大厦
法定代表人：高建平
联系人：梁曦
联系电话：021-52629999
客户服务电话：95561或拨打当地咨询电话
网址：www.cib.com.cn

（9）江苏银行
注册地址：南京市洪武北路55号
法定代表人：黄志伟
联系人：田春慧、法晓宁
联系电话：025-58587018、025-58587036
客户服务电话：96098、40086-96098
传真：025-58587038
网址：www.jsbchina.cn

（10）杭州银行
注册地址：杭州市庆春路46号杭州银行大厦
办公地址：杭州市庆春路46号杭州银行大厦
法定代表人：吴太普
联系人：严峻
联系电话：0571-85108195
客户服务电话：400-888-8508、0571-96523
传真：0571-85106576
网址：www.hzbank.com.cn

（11）华夏银行
注册地址：北京市东城区建国门内大街22号
办公地址：北京市东城区建国门内大街22号
法定代表人：吴建
联系人：马旭
联系电话：010-85238425
开放式基金咨询电话：95577
开放式基金业务传真：010-85238680
网址：www.hxb.com.cn

（12）广发证券
注册地址：广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316房）
办公地址：广东广州天河北路大都会广场18、19、36、38、41和42楼
法定代表人：王志伟
联系人：黄岚
客户服务电话：95575或致电各地营业网点
开放式基金业务传真：020-87555305
网址：www.gf.com.cn

（13）银河证券
注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人：顾伟国
联系人：田薇
客户服务电话：4008-888-8888
网址：www.chinastock.com.cn

（14）国泰君安证券
注册地址：上海市浦东新区商城路618号
办公地址：上海市银城中路168号上海银行大厦15楼
法定代表人：祝幼一
联系人：陶建银
开放式基金咨询电话：021-38676161
客户服务电话：400-8888-666
传真：021-38670666
网址：www.gtja.com

（15）招信证券
注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人：何如
联系人：齐晓燕
联系电话：0755-82130833
客户服务电话：95536
传真：0755-82133952
网址：www.guosen.com.cn

（16）申银万国证券
注册地址：上海市常熟路171号
办公地址：上海市常熟路171号
法定代表人：丁国荣
联系人：曹晔
联系电话：021-54033888
客户服务电话：95523、4008895523
传真：021-54038844
网址：www.swsc.com

（17）招商证券
注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层
办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层
法定代表人：宫少林
联系人：林生迎
联系电话：0755-82943666
客户服务电话：95565、400-8888-111
传真：0755-82943636
网址：www.newone.com.cn

（18）中信建投证券
注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址：北京市朝阳门内大街188号
法定代表人：张佑君
联系人：权唐
开放式基金咨询电话：400-8888-108
开放式基金业务传真：010-65182261
网址：www.csc108.com

（19）华泰证券
注册地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
办公地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人：吴万善
联系人：程尚峰
开放式基金咨询电话：95597
开放式基金业务传真：025-84579763
网址：www.htsc.com.cn

（20）海通证券
注册地址：上海市淮海中路98号
办公地址：上海市广东路689号
法定代表人：王开国
联系人：金芸、李笑鸣
联系电话：021-23219000
客户服务电话：95553、400-8888-001
传真：021-23219100
网址：www.htsec.com

（21）华泰联合证券
注册地址：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层（01A、02、03、04）、17A、18A、24A、25A、26A
办公地址：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第5层、17层、18层、24层、25层、26层
法定代表人：马昭明
联系人：盛宗凌
联系电话：0755-82492000
开放式基金咨询电话：95513
开放式基金业务传真：0755-82492962
网址：www.lhzq.com

（22）长江证券
注册地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦
办公地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人：胡运钊
联系人：李良
联系电话：027-65799999
客户服务电话：95579、4008-888-999
传真：027-85481900
网址：www.95579.com

（23）长城证券
注册地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人：黄耀华
联系人：匡婷
联系电话：0755-83516289
客户服务电话：0755-33680000、400-6666-888
传真：0755-83515567
网址：www.cgws.com

（24）招联证券
注册地址：无锡市县前东街168号
办公地址：无锡市县前东街168号
法定代表人：雷建辉
联系人：徐欣
开放式基金咨询电话：400-888-5288、0510-82588168
开放式基金业务传真：0510-82830162
网址：www.glsc.com.cn

（25）平安证券
注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
法定代表人：杨宇翔
联系人：郑舒丽
客户服务电话：400-881-6168
开放式基金业务传真：0755-82400862
网址：www.pingan.com

（26）招元证券
注册地址：合肥市寿春路179号
办公地址：合肥市寿春路179号
法定代表人：凤良志
联系人：陈琳琳
开放式基金咨询电话：95578
开放式基金业务传真：0551-2272100
网址：www.gyzq.com.cn

（27）招都证券
注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
法定代表人：常喆
联系人：黄静
联系电话：010-84183333
客户服务电话：400-818-8118
开放式基金业务传真：010-84183311-3389
网址：www.guodu.com

（28）世纪证券
注册地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦41-42楼
办公地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦41-42楼
法定代表人：卢长才
联系人：王佳佳
联系电话：0755-83199599转8172
开放式基金咨询电话：0755-83199511
开放式基金业务传真：0755-83199545
网址：www.csco.com.cn

（29）西部证券
注册地址：西安市东新街232号陕西信托大厦16-17层
办公地址：西安市东新街232号陕西信托大厦16-17层
法定代表人：刘建武
联系人：冯萍
联系电话：029-87406488
客户服务电话：029-95582
传真：029-87406387
网址：www.westsecu.com.cn

（30）长江证券
办公地址：山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼
注册地址：山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼
法定代表人：侯魏
联系人：郝磊
联系电话：0351-8686659
客户服务电话：95573或400-666-1618
传真：0351-8686619
网址：www.i618.com.cn

（31）东吴证券
注册地址：苏州市工业园区翠园路181号商旅大厦18-21层
办公地址：苏州市工业园区翠园路181号商旅大厦18-21层
法定代表人：吴永敏
联系人：方晓丹
联系电话：0512-65581136
客户服务电话：0512-33396288
传真：0512-65588021
网址：www.dwzq.com.cn

（32）东信证券
注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
深圳市福田区深南大道2008号中国风凰大厦1栋9层
法定代表人：牛冠兴
联系人：陈剑虹
联系电话：0755-82825551
客服电话：4008001001
传真：0755-82558355
网址：www.essence.com.cn

（33）万联证券
注册地址：广州市中山二路18号广东电信广场36-37层
办公地址：广州市中山二路18号广东电信广场36-37层
法定代表人：张建军
联系人：罗创武
联系电话：020-37865070
客户服务电话：400-8888-133
开放式基金业务传真：020-22373718-1013
网址：www.wlzq.com.cn

（34）南京证券
注册地址：江苏省南京市大钟亭8号
法定代表人：张华东
联系人：徐翔
联系电话：025-83367888-4201
客户服务电话：400-828-5888
传真：025-83320066
网址：www.njzq.com.cn

（35）财富证券
注册地址：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼
办公地址：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼
法定代表人：周晖
联系人：郭磊
联系电话：0731-84403360、0731-84403319
业务投诉电话：0731-84403350
开放式基金业务传真：0731-84403439
网址：www.cfzq.com

（36）东莞证券
注册地址：东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼
办公地址：东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼
法定代表人：张运勇
联系人：张巧玲
联系电话：0769-2211655
开放式基金咨询电话：0769-961130
开放式基金业务传真：0769-22119423
网站：www.dgzq.com.cn

（37）渤元证券
注册地址：海南省海口市南宝路36号证券大厦4层
办公地址：深圳市深南大道4001号时代金融中心17层
法定代表人：陆涛
联系人：马骁浩
联系电话：0755-83025022
客户服务电话：400-8888-228
传真：0755-83025625
网址：www.jyzq.com.cn

（38）国海证券
注册地址：广西南宁市滨湖路46号
办公地址：深圳市福田区竹子林四路光大银行大厦3楼
法定代表人：张雅锋
联系人：武斌
联系电话：0755-83707413
客户服务电话：95563
传真：0755-83700205
网址：www.ghzq.com.cn

（39）广州证券
注册地址：广州市先烈中路69号东山广场主楼十七楼
办公地址：广州市先烈中路69号东山广场主楼十七楼
法定代表人：吴志明
联系人：林洁茹
联系电话：020-87322668
客户服务电话：020-961303
传真：020-87325036
网址：www.gzs.com.cn

（40）第一创业证券
注册地址：广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层
办公地址：广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层
法定代表人：刘学民
联系人：崔国良
联系电话：0755-25832852
客户服务电话：0755-25832583
网址：www.firstcapital.com.cn

（41）招海证券
注册地址：天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
办公地址：天津市南开区宾水西道8号
法定代表人：杜庆平
联系人：王兆权
联系电话：022-28451861
客户服务电话：400-6515-988
传真：022-28451892
网址：www.bhzq.com

（42）万正证券
注册地址：湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
办公地址：湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
法定代表人：雷杰
联系人：邵艳霞
联系电话：0731-85832507
客户服务电话：95571
传真：0731-85832214
网址：www.founderse.com

（43）神投证券
注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层至21层
办公地址：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第18层至21层
法定代表人：杨明辉
联系人：刘毅
联系电话：0755-82023442
客户服务电话：400-600-8008
传真：0755-82026539
网址：www.cjhx.cn

（44）华航证券
注册地址：南昌市抚河北路291号
办公地址：南昌市抚河北路291号
法定代表人：杜航
联系人：余雅娜
联系电话：0791-6768763
客户服务电话：400-8866-567
传真：0791-6789414
网址：www.avicsec.com

（45）恒信证券
注册地址：内蒙古呼和浩特市锡林南路18号
法定代表人：孔佑杰
联系人：陈书彬
联系电话：010-88086830-730
客户服务电话：010-88086830
传真：010-66412537
网址：www.rxzq.com.cn

（46）民族证券
注册地址：青海省西宁市长江路53号汇通大厦6楼
法定代表人：裴东平
联系人：赵珊
联系电话：0755-33331188-8702
客户服务电话：4006543218
传真：0755-33329815
网址：www.tyzq.com.cn

（47）广发华福证券
注册地址：福州市古四路157号新天地大厦7、8层
办公地址：福州市古四路157号新天地大厦7至10层
法定代表人：黄金琳
联系人：张腾
联系电话：0591-87383623
客户服务电话：96326（福建省外请加拨0591）
传真：0591-87383610
网址：www.gfhfzq.com.cn

（48）信达证券
注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人：张志刚
联系人：唐静
联系电话：010-63081000
客户服务电话：400-800-8899
传真：010-63080978
网址：www.cindasc.com

（49）东兴证券
注册地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
法定代表人：徐勇力
联系人：汤漫川
联系电话：010-66555316
客户服务电话：400-8888-993
传真：010-66555246
网址：www.dxzq.net.cn

（50）华龙证券
注册地址：甘肃省兰州市静宁路308号
办公地址：兰州市城关区东岗西路638号财富大厦
法定代表人：李晓安
联系人：李昕田
联系电话：0931-4890208
客户服务电话：0931-4890100、4890619、4890618、4890208
传真：0931-4890118
网址：www.hlzqgs.com

（51）瑞银证券
注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
法定代表人：刘弘
联系人：谢亚凡
联系电话：010-58328752
客户服务电话：400-887-8827
网址：www.ubssecurities.com

（52）中山证券
注册地址：深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层
法定代表人：吴永良
联系人：李珍
客户服务电话：4001022011
网址：www.zszq.com.cn

（53）厦门证券
注册地址：厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼
办公地址：厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼
法定代表人：傅毅辉
联系人：卢金文
联系电话：0592-5161642
客户服务电话：0592-5163588
传真：0592-5161140
网站：www.xmzq.cn

（二）基金注册登记机构

易方达基金管理有限公司
注册地址：广东省珠海市香洲区情侣路428号九洲港大厦4001室
办公地址：广州市体育西路189号城建大厦25、26、27、28楼
法定代表人：梁棠
电话：400 881 8088
传真：020-38799249
联系人：余贤商

（三）律师事务所和经办律师

名称：北京市天元律师事务所
住所：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座11层
负责人：王立华
联系电话：010 88092188
传真：010 88092150
联系人：杨利
经办律师：陈华、杨利

（四）会计师事务所和经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人：杨绍信
联系电话：021 23238888
传真电话：021 23238800
联系人：金毅
经办注册会计师：薛竞、金毅

四、基金的名称

本基金名称：易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金

五、基金的类型

本基金类型：契约型开放式

六、基金的投资目标

紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。

七、基金的投资方向

本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括深证100ETF、深证100价格指数成份股及备选成份股、新股（一级市场初次发行和增发）、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

正常情况下，本基金资产中投资于深证100ETF的比例不低于基金资产净值的90%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。如果法律法规允许，本基金指数化投资（指对深证100ETF、深证100价格指数成份股及备选成份股的投资）的比例可以提高到基金资产净值的100%，同时业绩比较基准进行相应变更，该事项无须经基金份额持有人大会同意。

八、基金的投资策略

本基金为深证100ETF的联接基金。深证100ETF是主要采用完全复制法实现对深证100价格指数紧密跟踪的全被动指数基金，本基金主要通过投资于深证100ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争最终将年化跟踪误差控制在4%以内。

在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用实物申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行深证100ETF的买卖。

待指数衍生金融产品推出以后，本基金可以适度运用衍生金融产品进一步降低跟踪误差。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：深证100价格指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%。

如果深证100ETF变更业绩比较基准、或深证100价格指数编制单位变更或停止深证100价格指数的编制及发布、或深证100价格指数由其他指数替代、或深证100价格指数编制方法发生重大变更导致该指数不宜继续作为业绩比较基准的组成部分，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，履行必要手续后，调整业绩比较基准并及时公告。

十、基金的风险收益特征

本基金为深证100ETF的联接基金，主要通过投资于深证100ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与深证100价格指数的表现密切相关。理论上本基金预期风险与收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

十一、基金投资组合报告（未经审计）

本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金的托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同的规定，已于2011年6月30日复核了本投资组合报告。

本投资组合报告有关数据的期间为2011年1月1日至2011年3月31日。

1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	38,259,516.52	0.34
	其中：股票	38,259,516.52	0.34
2	基金投资	10,501,635,618.08	93.75
3	固定收益投资	446,895,000.00	3.99
	其中：债券	446,895,000.00	3.99
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	172,233,044.75	1.54
7	其他各项资产	42,787,193.03	0.38
8	合计	11,201,810,372.38	100.00

2. 期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	易方达深证100交易型开放式指数基金	股票型	交易型开放式（ETF）	易方达基金管理有限公司	10,501,635,618.08	94.30

3. 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	217,620.00	0.00
B	采掘业	2,671,786.13	0.02
C	制造业	22,608,231.36	0.20
C0	食品、饮料	5,667,503.79	0.05
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	245,152.74	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	2,053,390.14	0.02
C5	电子	1,299,744.50	0.01
C6	金属、非金属	3,617,414.08	0.03
C7	机械、设备、仪表	6,765,999.16	0.06
C8	医药、生物制品	2,153,056.05	0.02
C99	其他制造业	805,970.90	0.01
D	电力、煤气及水的生产和供应业	405,460.49	0.00
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	255,053.59	0.00
G	信息技术业	1,098,609.30	0.01
H	批发和零售贸易	1,468,074.64	0.01
I	金融、保险业	2,226,424.85	0.02
J	房地产业	2,694,481.13	0.02
K	社会服务业	967,118.10	0.01
L	传播与文化产业	2,107,977.44	0.02
M	综合类	1,538,679.49	0.01
	合计	38,259,516.52	0.34

4. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000895	双汇发展	40,243	2,823,046.45	0.03
2	000002	万科A	180,229	1,566,190.01	0.01
3	000793	华闻传媒	233,658	1,327,177.44	0.01
4	000858	五粮液	37,801	1,205,473.89	0.01
5	002024	苏宁电器	89,458	1,147,746.14	0.01
6	000527	美的电器	60,000	1,124,400.00	0.01
7	000069	华侨城A	65,390	967,118.10	0.01
8	000983	西山煤电	34,780	922,713.40	0.01
9	000001	深发展A	57,345	922,107.60	0.01
10	000063	中兴通讯	29,794	893,820.00	0.01

5. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	446,895,000.00	4.01
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	446,895,000.00	4.01

6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	1101015	11央行票据15	4,500,000	446,895,000.00	4.01

注：本基金本报告期末仅持有以上债券。

7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

9 投资组合报告附注

①本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

②本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

③其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	11,805,978.97
2	应收证券清算款	20,452,931.27
3	应收股利	-
4	应收利息	501,219.68
5	应收申购款	10,027,063.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	42,787,193.03

④报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

⑤报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	000895	双汇发展	2,823,046.45	0.03	重大事项停牌
2	000793	华闻传媒	1,327,177.44	0.01	重大事项停牌

十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金合同生效日为2009年12月1日，基金合同生效以来（截至2010年12月31日）的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
基金合同生效至2009年12月31日	0.10%	0.55%	1.49%	1.52%	-1.39%	-0.97%
2010年1月1日至2010年12月31日	-0.50%	1.60%	-3.88%	1.64%	3.38%	-0.04%
基金合同生效至2010年12月31日	-0.40%	1.54%	-2.45%	1.